

华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 12号

2024年第4季度报告

重要信息提示：

- 1、理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。
- 2、华夏理财有限责任公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏理财有限责任公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2024年10月1日至2024年12月31日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益纯债型日日开理财产品 12 号
理财产品代码	24112012
E 份额销售代码	24112012E
H 份额销售代码	24112012H
U 份额销售代码	24112012U
产品登记编码	Z7003924000188
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
产品投资性质	固定收益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR2 级（中低风险）
杠杆水平	102.35%
产品起始日期	2024-04-02
产品终止日期	无特定存续期限

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

第二章 净值、存续规模及收益表现

2.1 净值和存续规模

E 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)
2024-12-31	1.0209	672,753,938.08	1.0209	686,828,420.86

H 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)
2024-12-31	1.0217	2,566,458,694.72	1.0217	2,622,061,530.50

U 份额：

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)
2024-12-31	1.0152	903,493,600.34	1.0152	917,226,838.41

2.2 净值增长率

E 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024 年 09 月 30 日-2024 年 12 月 31 日	0.68%
成立以来	2024 年 04 月 02 日-2024 年 12 月 31 日	2.09%

H 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024 年 09 月 30 日-2024 年 12 月 31 日	0.71%
成立以来	2024 年 04 月 02 日-2024 年 12 月 31 日	2.17%

U 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024 年 09 月 30 日-2024 年 12 月 31 日	0.67%
成立以来	2024 年 06 月 14 日-2024 年 12 月 31 日	1.52%

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为 0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为 0 时，该年度净值增长率为空；**理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益，投资须谨慎。**

第三章 资产持仓

3.1 期末产品资产持仓情况

序号	资产类别	穿透前占总资产比例	穿透后占总资产比例
1	银行存款、债券买入返售、债券等固定收益类资产	14.42%	96.65%
2	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
3	权益类投资	0.00%	0.00%
4	金融衍生品	0.00%	0.00%
5	代客境外理财投资 QDII	0.00%	0.00%
6	商品类资产	0.00%	0.00%
7	另类资产	0.00%	0.00%
8	公募基金	2.37%	3.35%
9	私募基金	0.00%	0.00%
10	资产管理产品	83.21%	0.00%
11	委外投资——协议方式	0.00%	0.00%

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差；“权益类投资”类别中包含优先股。

3.2 期末产品持有的前十项资产

序号	资产名称	资产类别	持有金额 (元)	占总资产 的比例
1	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	2,357,980,596.18	54.52%
2	拆放同业及债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	535,763,052.32	12.39%
3	建设银行 202409125324	现金及银行存款	117,637,337.63	2.72%
4	建设银行 202409125325	现金及银行存款	117,606,161.82	2.72%
5	前海开源货币 B	公募基金	100,038,014.67	2.31%
6	农行合肥 20240627	现金及银行存款	32,426,462.12	0.75%
7	21 泰富优	债券	24,740,174.05	0.57%
8	23 汉投 07	债券	23,792,628.16	0.55%
9	24 新疆金投 CP001	债券	22,889,237.69	0.53%
10	中信百信银行 20241220	现金及银行存款	19,974,152.03	0.46%

3.3 期末产品持有的非标准化债权类资产

序号	融资客户	项目名称	交易结构	收益率 (%)	剩余期限 (天)	风险状况
-	-	-	-	-	-	-

3.4 报告期内关联交易情况

3.4.1 报告期内投资关联方发行的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	投资规模 (元)
-	-	-	-

3.4.2 报告期内投资关联方承销的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	投资规模 (元)
国信证券股份有限公司	144789	24 国电投海南绿色 ABS 优	5,701,996.92
国信证券股份有限公司	256318	24 宿经 01	599,959.41
开源证券股份有限公司	082482249	24 浙海宗正 ABN002 优 先	486,534.11
首创证券股份有限公司	144725	24 橙融 2A	1,093,607.16
首创证券股份有限公司	144934	宝元 01 优	775,443.69
首创证券股份有限公司	256469	24 雨山 01	783,845.66
招商证券股份有限公司	134092	24 穗开 Y6	7,054,610.92
招商证券股份有限公司	144710	荟享 18 号第 5 期优先 A 级(第 1 期次)	7,319,607.64
招商证券股份有限公司	144711	荟享 18 号第 5 期优先 B 级(第 1 期次)	506,742.07
招商证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	1,279,132.68
招商证券股份有限公司	263576	予鑫 4A	1,875,307.46
招商证券股份有限公司	263577	予鑫 4B	225,036.90

3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	投资规模 (元)
中诚信托有 限责任公司	ZC19KY	中诚信托-汇鑫 11 号	买入	306,840,000.00
中诚信托有	ZXD32Z2024	中诚信托-汇鑫 30 号	买入	105,140,000.00

限责任公司	01010032472			
-------	-------------	--	--	--

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

5.2 投资组合投资风险分析

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

本产品持仓债券未出现信用违约等信用风险事件,整体风险可控。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000970236

第七章 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。